

REGULAMENTUL DE PUNERE ÎN APLICARE (UE) 2015/2197 AL COMISIEI**din 27 noiembrie 2015****de stabilire a standardelor tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește valutele strâns corelate, în conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului****(Text cu relevanță pentru SEE)**

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Regulamentul (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și firmele de investiții și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 ⁽¹⁾, în special articolul 354 alineatul (3),

întrucât:

- (1) În cadrul abordării standardizate a riscului de piață, instituțiile pot să aplice cerințe de fonduri proprii mai mici pentru riscul valutar aferent pozițiilor puse în corespondență pe două valute atunci când acestea sunt considerate „strâns corelate” în conformitate cu metodologia prevăzută la articolul 354 alineatul (1) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013.
- (2) La precizarea valutei strâns corelate, ar trebui aplicată practica standard de la nivelul pieței constând în reducerea pierderii maxime dintr-o perioadă de 10 zile la pierderea maximă dintr-o zi, prin împărțirea variației maxime de 4 % a valutei la rădăcina pătrată a numărului 10. Prin urmare, pragul variației zilnice maxime a valorii în cadrul unei perechi de valute ar trebui fixat la 1,265 %.
- (3) Variațiile procentuale zilnice ale valutei ar trebui determinate prin calcularea diferenței dintre logaritmi naturali ai valorilor perechii de valute în cauză din două zile consecutive.
- (4) Valoarea absolută a procentajului rezultat ar trebui comparată cu pragul variației zilnice maxime a valorii unei perechi de valute, care este 1,265 %. Valorile care depășesc acest prag ar trebui considerate depășiri ale pierderii maxime de 4 % pentru o perioadă de 10 zile.
- (5) Este necesară determinarea unui număr maxim de pierderi acceptabile, după depășirea căruia perechile de valute să nu mai fie considerate corelate în sensul articolului 354 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013. În plus, la calcularea numărului maxim de pierderi acceptabile ar trebui să fie avute în vedere atât pozițiile lungi, cât și pozițiile scurte pe valuta respectivă. Numărul de depășiri autorizate ar trebui să fie rotunjit în minus și stabilit la șapte depășiri ale pierderii maxime în cursul celor trei ani precedenți și la 65 de depășiri ale pierderii maxime în cursul celor cinci ani precedenți.
- (6) La articolul 354 alineatul (1) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 se prevăd cerințe de fonduri proprii mai mici numai pentru pozițiile pe „valute strâns corelate relevante”. Prin urmare, numai perechile valutare constituite prin combinarea unei valute a unui stat membru cu o valută ce figurează pe o listă de valute din țări terțe care sunt relevante pentru instituțiile financiare din Uniune ar trebui evaluate aplicând criteriile pentru determinarea valutei strâns corelate.
- (7) O serie de alte perechi valutare, alcătuite exclusiv din valute ale unor țări terțe, ar trebui la rândul lor incluse în evaluare, dată fiind relevanța lor pentru portofoliile instituțiilor din Uniune. În plus, având în vedere cerințele de la articolul 354 alineatul (1) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 referitoare la perioadele de observare relevante, ar trebui incluse în evaluare numai valutele pentru care este disponibilă, dintr-o sursă fiabilă, o serie de date zilnice pe o durată de cinci ani.
- (8) Articolul 354 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 prevede un tratament specific pentru perechile de valute formate din valute ale statelor membre participante la cea de a doua etapă a uniunii economice și monetare („MCS II”) și euro sau din astfel de valute combinate între ele. Prin urmare, perechile în care sunt implicate valutele respective nu ar trebui considerate „relevante”. Cu toate acestea, ar trebui considerate „relevante” perechile formate dintr-o valută a unui stat participant la MCS II, pe de o parte, și o altă valută decât euro sau o valută a unui alt stat participant la MCS II, pe de altă parte.

⁽¹⁾ JO L 176, 27.6.2013, p. 1.

- (9) Prin urmare, ar trebui evaluată corelarea din cadrul fiecărei perechi de valute constituite prin combinarea valurilor prevăzute în anexa la prezentul regulament.
- (10) Pentru a asigura siguranța privind utilizarea listei de valute strâns corelate, lista în cauză ar trebui reexaminată în conformitate cu articolul 29 alineatul (1) litera (d) din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010 al Parlamentului European și al Consiliului ⁽¹⁾. Din aceleași motive, reexaminarea în cauză ar trebui efectuată la intervale regulate și la aceeași dată sau aproximativ la aceeași dată în fiecare an, cu excepția cazurilor în care evoluțiile de pe piață impun ca această reexaminare să fie efectuată în mod excepțional în alte momente.
- (11) Prezentul regulament se bazează pe proiectele de standarde tehnice de punere în aplicare prezentate Comisiei Europene de către Autoritatea Bancară Europeană.
- (12) Autoritatea Bancară Europeană a efectuat consultări publice deschise cu privire la proiectele de standarde tehnice de punere în aplicare pe care se bazează prezentul regulament, a analizat costurile și beneficiile potențiale aferente și a solicitat avizul Grupului părților interesate din domeniul bancar, instituit în conformitate cu articolul 37 din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

Articolul 1

Perechile de valute care îndeplinesc cerințele de la articolul 354 alineatul (1) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 figurează în anexa la prezentul regulament.

Articolul 2

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în toate statele membre.

Adoptat la Bruxelles, 27 noiembrie 2015.

Pentru Comisie
Președintele
Jean-Claude JUNCKER

⁽¹⁾ Regulamentul (UE) nr. 1093/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea Bancară Europeană), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/78/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 12).

ANEXĂ

Lista de valute strâns corelate*Partea 1 – Lista valutilor strâns corelate cu euro (EUR)*

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), lira sterlină britanică (GBP), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON).

Partea 2 – Lista valutilor strâns corelate cu dirhamul din Emiratele Arabe (AED)

Kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 3 – Lista valutilor strâns corelate cu lekul albanez (ALL)

Marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), euro (EUR).

Partea 4 – Lista valutilor strâns corelate cu kwanza angoleză (AOA)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), yuanul chinezesc (CNY), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 5 – Lista valutilor strâns corelate cu marca din Bosnia și Herțegovina (BAM)

Lekul albanez (ALL), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), lira sterlină britanică (GBP), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), euro (EUR).

Partea 6 – Lista valutilor strâns corelate cu leva bulgărească (BGN)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), lira sterlină britanică (GBP), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), euro (EUR).

Partea 7 – Lista valutilor strâns corelate cu dolarul canadian (CAD)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), dolarul din Hong Kong (HKD), pataca din Macao (MOP), dolarul din Singapore (SGD), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 8 – Lista valutilor strâns corelate cu yuanul chinezesc (CNY)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 9 – Lista valutilor strâns corelate cu coroana cehă (CZK)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana daneză (DKK), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), euro (EUR).

Partea 10 – Lista valutilor strâns corelate cu coroana daneză (DKK)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), lira sterlină britanică (GBP), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), dolarul din Singapore (SGD).

Partea 11 – Lista valutilor strâns corelate cu lira sterlină britanică (GBP)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), yuanul renminbi chinezesc (CNY), coroana daneză (DKK), dolarul din Hong Kong (HKD), coroana croată (HRK), lira libaneză (LBP), dirhamul marocan (MAD), pataca din Macao (MOP), dolarul din Singapore (SGD), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD), euro (EUR).

Partea 12 – Lista valutilor strâns corelate cu dolarul din Hong Kong (HKD)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 13 – Lista valutilor strâns corelate cu coroana croată (HRK)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), lira sterlină britanică (GBP), dirhamul marocan (MAD), leul românesc (RON), dolarul din Singapore (SGD), euro (EUR).

Partea 14 – Lista valutilor strâns corelate cu wonul sud-coreean (KRW)

Solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), dolarul taiwanez (TWD).

Partea 15 – Lista valutilor strâns corelate cu lira libaneză (LBP)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 16 – Lista valutilor strâns corelate cu dirhamul marocan (MAD)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), lira sterlină britanică (GBP), coroana croată (HRK), leul românesc (RON), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), euro (EUR).

Partea 17 – Lista valutilor strâns corelate cu pataca din Macao (MOP)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 18 – Lista valutilor strâns corelate cu solul nou peruvian (PEN)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), yuanul renminbi chinezesc (CNY), dolarul din Hong Kong (HKD), wonul sud-coreean (KRW), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 19 – Lista valutilor strâns corelate cu pesoul filipinez (PHP)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), yuanul renminbi chinezesc (CNY), dolarul din Hong Kong (HKD), wonul sud-coreean (KRW), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), ringgitul malaysian (MYR), solul nou peruvian (PEN), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 20 – Lista valutilor strâns corelate cu leul românesc (RON)

Lekul albanez (ALL), marca din Bosnia și Herțegovina (BAM), leva bulgărească (BGN), coroana cehă (CZK), coroana daneză (DKK), coroana croată (HRK), dirhamul marocan (MAD), euro (EUR).

Partea 21 – Lista valutilor strâns corelate cu dolarul din Singapore (SGD)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), coroana daneză (DKK), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), coroana croată (HRK), wonul sud-coreean (KRW), lira libaneză (LBP), dirhamul marocan (MAD), pataca din Macao (MOP), ringgitul malaysian (MYR), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 22 – Lista valutilor strâns corelate cu bahtul thailandez (THB)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), yuanul renminbi chinezesc (CNY), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), dirhamul marocan (MAD), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), dolarul taiwanez (TWD), dolarul american (USD).

Partea 23 – Lista valutilor strâns corelate cu dolarul taiwanez (TWD)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), wonul sud-coreean (KRW), lira libaneză (LBP), dirhamul marocan (MAD), pataca din Macao (MOP), ringgitul malaysian (MYR), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul american (USD).

Partea 24 – Lista valutilor strâns corelate cu dolarul american (USD)

Dirhamul din Emiratele Arabe (AED), kwanza angoleză (AOA), dolarul canadian (CAD), yuanul renminbi chinezesc (CNY), lira sterlină britanică (GBP), dolarul din Hong Kong (HKD), lira libaneză (LBP), pataca din Macao (MOP), solul nou peruvian (PEN), pesoul filipinez (PHP), dolarul din Singapore (SGD), bahtul thailandez (THB), dolarul taiwanez (TWD).
